DAILY SIGNAL

平成30年4月18日(水)
上田八木短資株式会社TEL0120-327-017

§ 4/18 のオペと市場動向

本日の無担保コールON物は▲0.065%の出合から始まった。
その後は主に▲0.075～▲0.045%の水準で取引された。
調達一巡後はビッドが薄くなり、▲0.086%での出合も見られ、引けた。

(単位:億円)

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想			
	4/18(水)		4/19(木)		4/20(金)		4/23(月)	
券	▲700		▲1,600		▲2,000		▲1,000	
財政	+3,000		▲18,200		+0		▲5,000	
過不足	+2,300		▲19,800		▲2,000		▲6,000	
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入						+11,300		
国庫短期証券買入								
国債買現先								
国債売現先								
共通担保(本店)								
共通担保(全店)							▲1,600	
CP買現先								
CP等買入			▲100					
社債等買入								
ETF買入		+700		+200				
J－REIT買入								
被災地金融機関支援					▲1,100	+1,300		
貸出								
国債補完供給	+2,900	▲3,000	+3,000					
米ドル供給用担保国債供給								
成長基盤強化支援								
貸出増加支援								
当座預金増減	+2,900		▲16,700		+9,500		▲7,600	
当座預金残高	3,868,400		3,851,700		3,861,200		3,853,600	
準備預金残高	3,386,700		主な需給要因					
積み終了先	3,352,400		国債発行(5年)		国庫短期証券発行・償還(1Y)		国庫短期証券発行・償還(3M) 国債発行(20年)	
超過準備	3,328,400							
非準預先残高	481,700							
準備預金進捗率	98.7%							
平均	10.0%		予想込増減	▲16,700	予想込増減	+9,500		▲7,600
乖離率	88.7%		当預見込	3,851,700	当預見込	3,861,200	当預見込	3,853,600

4/18 のオペ結果

9:20
ノーオペ
10:10
国債買入(4/20-)
(残存1年超3年以下)
+0.002% 按分(28.6%)2,507億
(残存3年超5年以下)
▲0.002% 按分(29.3%)3,306億
(残存5年超10年以下)
▲0.002% 按分(68.8%)4,507億
(変動利付債)
▲0.100円 按分(33.1%)1,004億
11:50
国債補完供給(4/18-4/19)
▲0.600% 全取 2,909億

12:50
ノーオペ
13:00
ノーオペ

共通担保(全店)	3,292
国債買現先	0
CP買現先	0
成長基盤強化	101,961
被災地金融機関支援	4,921
ロンバート残高	0

今 積み期間の所要準備額(積数) 3,000,800
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(積数) 40,100
4/19 以降の残り積み立て額(残り所要)(平均) 1,500

	T/N		T+2	
	無担	ユーロ円	CP現先	レポG.C
オファー	-0.050	-	-0.100	-0.180
ビッド	-0.060	-	0.000	-0.160
出来値	-	-	-	-

4/17 時点のマネタリーベース(単位:億円) 4,948,000

(参考)日銀B/S(単位:兆円)

	16年末実績	17年末実績	4/10
長期国債	361	419	430
CP等	2.3	2.2	2.2
社債等	3.2	3.2	3.2
ETF	11.1	17.2	19.2
J－REIT	0.36	0.45	0.47
貸出支援基金	41	50	48
国庫短期証券	50	22	20
その他とも資産計	476	521	530
銀行券	102	107	103
当座預金	330	368	378
その他とも負債・純資産計	476	521	530

T-Billの入札結果(直近3回)

入札日	回号	最高利回	平均利回
4/18	752 (1Y)	-0.1757%	-0.1796%
4/12	751 (3M)	-0.1625%	-0.1685%
4/6	750 (6M)	-0.1534%	-0.1594%

4/17 のコール市場残高(前日比)

合計	94,819	-4,458
有担	14,726	-285
無担	80,093	-4,173

*出所:営業毎旬報告
*貸出支援基金には米ドル特則分含む。

無担保コールレート速報	ON	TN	SN	1W	2W	3W	1M	2M	3M	6M	1Y
最低	-0.086	-	-	-0.045	-0.055	-0.010	-0.050	-	-	-	-
最高	0.001	-	-	0.230	0.000	0.001	0.001	-	-	-	-
加重平均	-0.063	0.000	-	-0.010	-0.039	-0.002	-0.033	-	-	-	-
東京レポ・レート	-0.150	-0.166	-	-0.161	-0.210	-0.206	-0.199	-	-0.161	-0.157	-0.166

§ 4/19 の市場動向予想

足許は▲0.086～+0.001%のレンジで取引されよう。

4/19 の予定(国内)

14:00 4月の金融システムレポート(日銀)

4/19 の予定(海外)

米 4月のフィラデルフィア連銀景況感
3月の景気先行指数
ユーロ圏 2月の経常収支

国庫短期証券入札予定		国債入札予定	
4月19日	3ヶ月 第753回	4月19日	20年
4月26日	3ヶ月	4月24日	2年
5月2日	3ヶ月	5月8日	10年
5月9日	6ヶ月	5月10日	物価連動

翌営業日の出合いレンジ予想

ON	S1W	S2W	S3W	S1M	S2M	S3M	S6M	S1Y
-0.086	-0.055	-0.055	-0.050	-0.050	-0.040	-0.020	-0.010	-0.010
～	～	～	～	～	～	～	～	～
0.001	0.010	0.010	0.010	0.030	0.030	0.060	0.120	0.130

日銀の国庫短期証券保有状況

4月10日 時点の日銀保有残		173,533[億円]
内、4月末までの償還分		-11,390[億円]
04月10日以降の国庫短期証券追加買入分	4/11 スタート分	5,002[億円]
	4/17 スタート分	2,500[億円]
現時点の4月末合計額		169,645[億円]

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100～1,000億程度	500億	月2回程度	4月6日	1
1年超3年以下	2,000～3,000億程度	2500億	4 6 11 13 18 23	4月18日	1
3年超5年以下	2,500～3,500億程度	3300億			
5年超10年以下	3,000～5,000億程度	4500億	4 9 11 18 20 25	4月18日	2
10年超25年以下	1,500～2,500億程度	1900億	2 9 13 20 25	4月13日	2
25年超	500～1,500億程度	700億			
物価連動債	250億程度	250億	月2回程度	4月2日	1
変動利付債<偶数月>	1,000億程度	1000億	月1回	4月18日	0

本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。 上田八木短資株式会社 登録金融機関 近畿財務局長(登金)第 243号 加入協会 日本証券業協会